

汇添富上证综合指数证券投资基金

更新招募说明书摘要

(2020年4月14日更新)

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

汇添富上证综合指数证券投资基金（基金简称：汇添富上证综合指数；基金代码：470007；以下简称“本基金”）经2009年5月8日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】371号文核准募集。本基金基金合同于2009年7月1日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资人拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，等等。本基金是股票型基金，属证券投资基金中的较高风险收益品种。投资者应充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管

理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本基金更新招募说明书“基金的投资”章节中有关“风险收益特征”的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行“销售适当性风险评价”，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的基金产品“风险等级评价”与“基金的投资”章节中“风险收益特征”的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不向投资者保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过 50%的除外。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新，同时对基金管理人、基金托管人、财务数据和净值表现等其他信息一并更新，更新所载内容截止日为 2020 年 4 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

（一）基金管理人简况

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼

法定代表人：李文

成立时间：2005 年 2 月 3 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监基金字[2005]5号

注册资本：人民币 132,724,224 元

联系人：李鹏

联系电话：021-28932888

股东名称及其出资比例：

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

李文先生，2015年4月16日担任董事长。国籍：中国，厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长，汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长，中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副局长、副局长，中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长，东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理，稽核总部总经理，东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理，汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生，2016年11月20日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理，上海上报资产管理有限公司董事长，上海文化产权交易所股份有限公司董事长，上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记，上海机械进出口(集团)有限公司副总裁，上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长，上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长，上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任，上海国际集团有限公司行政管理总部总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理，上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长，上海国有

资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生，2018年3月21日担任董事。国籍：中国，上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理，东航集团财务有限责任公司副总经理，国泰人寿保险有限责任公司副总经理，东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

张晖先生，2015年4月16日担任董事，总经理。国籍：中国，上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理，汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师，富国基金管理有限公司研究主管和基金经理，汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监，曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生，2015年4月16日担任独立董事。国籍：中国香港，厦门大学经济学博士，加拿大Saskatchewan大学工商管理理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员会计划财务处会计，五大国际会计师事务所Touche Ross International(现为德勤)加拿大多伦多分所审计员，厦门大学会计师事务所副主任会计师，厦门大学经济学院讲师、副教授，伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者，美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者，加拿大Lethbridge大学管理学院会计学讲师、副教授(tenured)，香港大学商学院访问教授，香港浸会大学商学院会计与法律系教授，博导，系主任。

杨燕青女士，2011年12月19日担任独立董事，国籍：中国，复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑，第一财经研究院院长，国家金融与发展实验室特邀高级研究员，上海政协委员，《第一财经日报》创始编委之一，第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人，《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进(Shangjin Wei)先生，2020年1月9日担任独立董事，国籍：美国，加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授，世界银行顾问，国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。

2、监事会成员

任瑞良先生，2004年10月20日担任监事，2015年6月30日担任监事会主席。国籍：中国，大学学历，会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管，文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生，2015年9月8日担任监事。国籍：中国，硕士研究生，注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员，金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任（主持工作），东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生，2015年6月30日担任监事，国籍：中国，国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司，东航集团财务有限责任公司。

王静女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部，东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士，2008年2月23日担任职工监事，国籍：中国，华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监，汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生，2013年8月8日担任职工监事，国籍：中国，北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司，泰科电子（上海）有限公司能源事业部。

3、高管人员

李文先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

张晖先生，2015年6月25日担任总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

雷继明先生，2012年3月7日担任副总经理。国籍：中国，工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理，中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011年12月加盟汇添富基金管理

股份有限公司，现任公司副总经理。

娄焱女士，2013年1月7日担任副总经理。国籍：中国，金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作，负责投资银行、证券投资研究，以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任公司副总经理。

袁建军先生，2015年8月5日担任副总经理。国籍：中国，金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理，汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理，并于2014年至2015年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005年4月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生，2017年3月3日担任副总经理。国籍：中国，武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长，厦门建行信用卡部副处长、处长，厦门建行信息技术部处长，建总行北京开发中心负责人，建总行信息技术管理部副总经理，建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任，建总行信息技术管理部资深专员（副总经理级）。2016年9月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生，2015年6月25日担任督察长。国籍：中国，上海财经大学经济学博士，历任上海证监局主任科员、副处长，上海农商银行同业金融部副总经理，汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理

（1）现任基金经理

吴振翔先生，国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。14年证券从业经验。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008年3月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010年2月5日至今任汇添富上证综合指数基金的基金经理，2011年9月16日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金的基金经理，2011年9

月28日至2013年11月7日任汇添富深证300ETF基金联接基金的基金经理，2013年8月23日至2015年11月2日任中证主要消费ETF基金、中证医药卫生ETF基金、中证能源ETF基金、中证金融地产ETF基金的基金经理，2013年11月6日至今任汇添富沪深300安中指数基金的基金经理，2015年2月16日至今任汇添富成长多因子股票基金的基金经理，2015年3月24日至今任汇添富主要消费ETF联接基金的基金经理，2016年1月21日至今任汇添富中证精准医指数基金的基金经理，2016年7月28日至今任中证上海国企ETF的基金经理，2016年12月22日至今任汇添富中证互联网医疗指数（LOF）的基金经理，2017年8月10日至今任汇添富中证500指数（LOF）的基金经理，2018年3月23日至今任添富价值多因子股票的基金经理，2019年7月26日至今任添富中证长三角ETF的基金经理，2019年9月24日至今任汇添富中证长三角ETF联接的基金经理，2019年11月6日任添富中证国企一带一路ETF的基金经理，2020年3月5日任添富中证国企一带一路ETF联接基金的基金经理。

（2）历任基金经理

何仁科先生，2009年7月1日至2011年11月25日任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会

主席：袁建军先生（副总经理）

成员：韩贤旺（首席经济学家）、王栩（总经理助理，权益投资总监）、陆文磊（总经理助理，固定收益投资总监）、劳杰男（研究总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

(1) 汇添富基金管理股份有限公司直销中心

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932893

传真：（021）50199035 或（021）50199036

联系人：陈卓膺

客户服务电话：400-888-9918（免长途话费）

网址：www.99fund.com

邮箱：guitai@htffund.com

(2) 汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）

2、代销机构

本基金的代销机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并在基金管理人网站公示。

(二) 注册登记机构

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

办公地址：上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼

法定代表人：李文

电话：（021）28932888

传真：（021）28932876

联系人：韩从慧

(三) 律师事务所和经办律师

名称：广东东方昆仑律师事务所上海分所

住所：上海市延安西路 728 号华敏·翰尊国际大楼 13 楼 F 座

负责人：陈冉

电话：021-62113098

传真：021-62112108

经办律师：田卫红、汪年俊

联系人：田卫红

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

邮政编码：100738

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

业务联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、许培菁

四、基金的名称

本基金名称：汇添富上证综合指数证券投资基金

基金简称：汇添富上证综合指数

基金代码：470007

五、基金的类型

本基金为契约型开放式股票型基金。

六、基金的投资目标

本基金采取抽样复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于6%，以实现对基准指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括上海证券交易所上市交易的所有股票、新股（如一级市场初次发行或增发）等，其中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%（但因法律法规限制原因导致本基金不能投资相关股票而致使本基金不能达到上述比例的情形除外）。今后如果法律法规允许，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%。

如以后法律法规及中国证监会允许基金投资其他金融工具，如股指期货、ETF 等，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一） 投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证综合指数的相关性，主要选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%且年化跟踪误差小于 6%的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

（一） 资产配置

本基金采用自上而下的两层资产配置策略，首先确定基金资产在股票和现金之间的配置比例，再进一步以抽样复制基准指数的方法，确定抽样组合中各股票的配置比例。本基金股票资产比例原则上将不低于基金资产净值的 90%，现金或

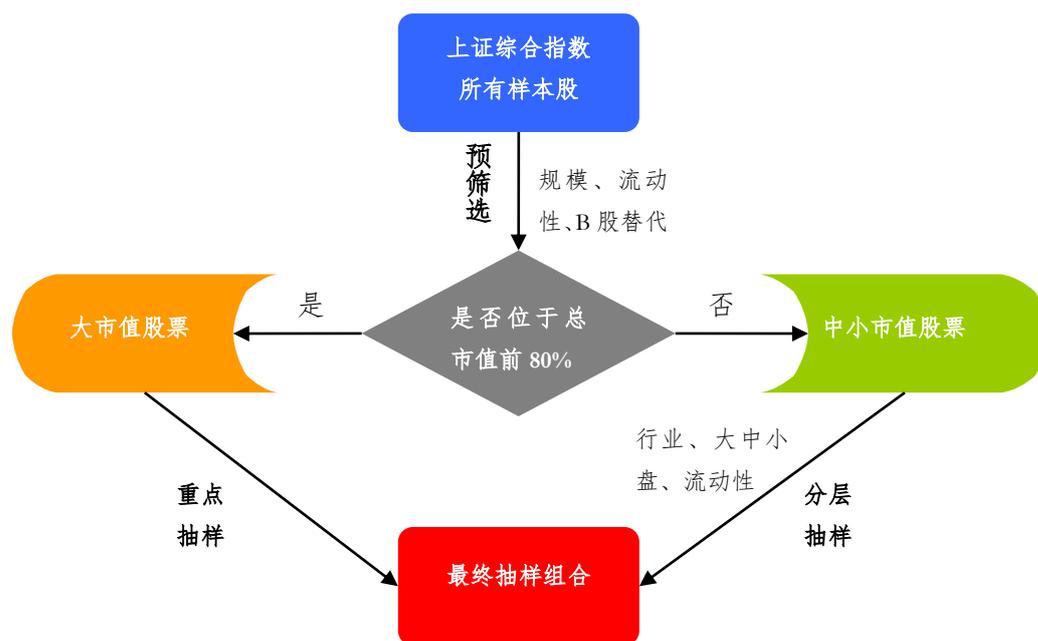
者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

如果法律法规允许，本基金的股票投资比例可以提高到基金资产净值的 100%，此事项无须经基金份额持有人大会同意。

（二）抽样股票组合构建

本基金原则上采用抽样复制基准指数的方法，在综合考虑个股的总市值规模、流动性、行业代表性及抽样组合与上证指数的相关性等因素的基础上，采用“重点抽样 + 分层抽样”的方法，选择上海证券交易所上市交易的部分股票构建基金的抽样股票投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的个股配置比例。

汇添富上证综合指数基金抽样复制流程



（1）股票预筛选

由于上证指数包含在上海证券交易所上市交易的所有 A 股和 B 股股票，本基金在抽样复制时，将首先从样本中剔除市值极小及流动性极差的股票。

（2）重点抽样

将预筛选出来的股票，按总市值从大到小排序，逐个累加总市值，累计总市值在前 80% 的股票，按照其在上证综合指数的比例进入抽样组合。

（3）分层抽样

对于累计总市值在后 20%的股票，按照行业分类在每个行业中进行抽样选取行业优化组合。

（4）确定最终抽样组合

对于“重点抽样 + 分层抽样”方法得到的股票，将被用来构建本基金的最最终股票抽样组合。

针对当前上证综合指数个股集中度较高的特点，本基金采取了“重点抽样 + 分层抽样”的方法对基准指数进行抽样复制。为了能够更好的跟踪上证综合指数，如果今后由于基准指数成份股结构的变化，其他抽样复制方法将更适合对基准指数的跟踪，本基金将做相应的变更。对于抽样复制方法的变更，无需召开基金份额持有人大会，但本基金管理人需在方法变更前 2 日内在指定媒介上刊登公告，并阐明变更抽样复制方法的原因。

（三）股票组合调整

（1）组合调整原则

本基金为抽样复制的指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

在重点抽样调整时，如果已选股票位于累计总市值前 85%则优先保留，原样本外股票如果位于累计总市值前 75%则优先进入；在进行抽样组合调整时，如果已选股票在行业中所属类中流动性排名没有显著变化，则优先保留。

（2）投资组合调整方法

①对基准指数的跟踪调整

A、定期季度调整

本基金所构建的指数化投资组合为经过优化处理的抽样复制组合，将每季度末根据上述抽样复制方法调整股票组合及个股配置比例。

B、不定期调整

根据指数编制规则，当上证综合指数成份股因新股发行、增发、送配等股权

变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据抽样复制方法对股票组合进行相应调整。

②限制性调整

A、大额赎回调整

由于本基金开放式基金的特点，当发生大额赎回超过现金保有量时，本基金将对股票投资组合进行同比例的被动性卖出调整，以保证基金正常运行。

B、流动性调整

如果因抽样组合中个股停牌限制、交易量暂时不足等市场流动性因素，使得基金管理人无法顺利购买某成份股，本基金管理人将视当时市场情况，综合考虑投资者利益和跟踪误差最小化，决定部分持有现金或买入相关的替代性股票。替代股票的选取遵循“同行业基础上价格相关性”原则，对于需要进行替代的股票，其替代股票将从沪深两市挂牌交易的 A 股股票中选取，具体将在考虑股票流动性等因素的前提下，在同行业范围内，选取相关性较大的股票进行替代。

C、针对上证综合指数的新股纳入规则，本基金将综合考虑新股发行价和预估中签率，适量参与一级市场新股认购。

D、为使得基金收益率尽可能地贴近所跟踪基准指数的收益率，本基金可能使用金融衍生产品，以对冲某些成份股的特殊突发风险和某些特殊情况下的流动性风险。

E、在其他不影响指数复制的情况下，本基金管理人可以根据市场情况，在跟踪误差最小化的条件下，对基金资产组合进行适当的调整。

(二) 投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

以《基金法》和本基金基金合同等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

(1) 投资决策委员会

负责制定基金投资方面的整体战略和原则；审定基金定期投资检讨报告；决定基金禁止的投资事项等。

(2) 基金经理

负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。

3、投资决策程序

本基金具体的投资决策机制与流程为：

(1) 金融工程小组运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对指数化投资的偏差风险和流动性风险进行测算，并提供数量化风险分析报告；投资研究部对基准指数成份股中基本面变化、流动性变化的企业情况提供及时的风险分析报告；营运支持部每日提供基金申购赎回的数据分析报告，供基金经理决策参考；

(2) 投资决策委员会定期召开会议，依据上述报告对资产配置制定整体投资战略；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议做出决策；

(3) 基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告，在追求相关度最大化和跟踪误差最小化的目标下，采取适当的方法，控制股票组合与指数的偏差风险、流动性风险，降低交易成本；

(4) 交易部门依据基金经理的指令，制定交易策略，通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖；

(5) 风险控制委员会根据市场变化对指数化投资组合的资产配置和调整提出风险防范建议；金融工程小组对投资组合的偏离度风险进行实时跟踪和评估，并对风险隐患提出预警；稽核监察部对指数化抽样复制的执行过程进行风险监控；基金经理依据申购赎回和成份股停牌等情况控制投资组合的流动性风险。

(三) 投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、

基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金应在基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定；

(2) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定；

(3) 现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(4) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(5) 本基金主动投资流动性受限资产的市值合计不得超过本基金基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述投资比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(6) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手方开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(7) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

除上述第 (3)、(5)、(6) 项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规

另有规定的从其规定。

九、基准指数与业绩比较基准

本基金股票资产的基准指数为上证综合指数。

本基金业绩比较基准为：

上证综合指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%

上证综合指数以上海证券交易所上市交易的全部股票作为样本，能够全面反映股市运行的特点，是中国最具影响力的指数。指数专家委员会的成立保证了指数编制方法的科学性，同时 2007 年 1 月取消了“新股上市首日纳入股指”的规定则为复制上证综合指数成为可能。

如果上证综合指数被停止编制及发布，或上证综合指数由其他指数替代(单纯更名除外)，或由于指数编制方法等重大变更导致上证综合指数不宜继续作为基准指数，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后变更本基金的基准指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的基准指数，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的标的指数和业绩比较基准，并在变更前提前 2 日在指定媒介上公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高风险较高收益的品种。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

投资组合报告

1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,041,494,587.53	94.36
	其中：股票	1,041,494,587.53	94.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	60,577,100.95	5.49
8	其他各项资产	1,677,023.09	0.15
9	合计	1,103,748,711.57	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,854,622.54	0.17
B	采矿业	86,078,046.43	7.84
C	制造业	354,568,435.92	32.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,177,913.25	3.93
E	建筑业	32,737,840.51	2.98
F	批发和零售业	27,226,444.57	2.48
G	交通运输、仓储和邮政业	48,384,038.88	4.41
H	住宿和餐饮业	2,562,745.86	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,271,645.42	1.94
J	金融业	360,125,091.71	32.79
K	房地产业	34,851,854.33	3.17
L	租赁和商务服务业	8,980,672.56	0.82

M	科学研究和技术服务业	1,580,307.30	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	3,507,880.88	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,794,852.97	0.89
S	综合	4,463,966.50	0.41
	合计	1,041,166,359.63	94.79

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	328,227.90	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	328,227.90	0.03

1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

1.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	46,362	54,846,246.00	4.99
2	601288	农业银行	13,127,973	48,442,220.37	4.41
3	600036	招商银行	1,160,715	43,619,669.70	3.97
4	601988	中国银行	10,008,711	36,932,143.59	3.36
5	601318	中国平安	375,103	32,056,302.38	2.92
6	601857	中国石油	4,403,257	25,670,988.31	2.34
7	601628	中国人寿	723,571	25,230,920.77	2.30
8	601328	交通银行	3,148,117	17,723,898.71	1.61
9	600028	中国石化	3,294,977	16,837,332.47	1.53
10	601166	兴业银行	721,706	14,289,778.80	1.30
11	601939	建设银行	1,952,011	14,113,039.53	1.28
12	600900	长江电力	761,011	13,987,382.18	1.27
13	600276	恒瑞医药	156,869	13,729,174.88	1.25
14	600000	浦发银行	974,092	12,049,518.04	1.10
15	603288	海天味业	97,275	10,458,035.25	0.95
16	601088	中国神华	572,815	10,453,873.75	0.95
17	600104	上汽集团	405,999	9,683,076.15	0.88
18	600030	中信证券	338,400	8,561,520.00	0.78
19	601601	中国太保	224,878	8,509,383.52	0.77
20	601668	中国建筑	1,467,085	8,245,017.70	0.75
21	600016	民生银行	1,238,108	7,812,461.48	0.71
22	600585	海螺水泥	142,381	7,802,478.80	0.71
23	601998	中信银行	1,196,872	7,384,700.24	0.67
24	600031	三一重工	427,794	7,293,887.70	0.66
25	601225	陕西煤业	770,881	6,930,220.19	0.63
26	600048	保利地产	418,669	6,774,064.42	0.62
27	600887	伊利股份	216,161	6,688,021.34	0.61
28	601688	华泰证券	326,960	6,640,557.60	0.60
29	601888	中国国旅	73,105	6,502,689.75	0.59
30	601818	光大银行	1,393,067	6,143,425.47	0.56
31	601766	中国中车	851,861	6,082,287.54	0.55
32	600009	上海机场	72,765	5,730,243.75	0.52
33	600050	中国联通	878,342	5,173,434.38	0.47
34	601211	国泰君安	264,600	4,892,454.00	0.45
35	601229	上海银行	498,006	4,726,076.94	0.43

36	600018	上港集团	818,390	4,722,110.30	0.43
37	601658	邮储银行	796,668	4,548,987.78	0.41
38	600745	闻泰科技	48,400	4,477,000.00	0.41
39	600019	宝钢股份	776,055	4,454,555.70	0.41
40	600837	海通证券	285,886	4,419,797.56	0.40
41	600690	海尔智家	223,300	4,354,350.00	0.40
42	601100	恒立液压	87,235	4,339,941.25	0.40
43	601006	大秦铁路	521,344	4,280,234.24	0.39
44	600183	生益科技	200,853	4,201,844.76	0.38
45	600309	万华化学	74,611	4,190,899.87	0.38
46	601186	中国铁建	405,059	4,107,298.26	0.37
47	603160	汇顶科技	19,004	3,920,525.20	0.36
48	601989	中国重工	741,929	3,887,707.96	0.35
49	601390	中国中铁	645,228	3,832,654.32	0.35
50	601800	中国交建	414,939	3,800,841.24	0.35
51	601336	新华保险	76,355	3,752,848.25	0.34
52	600999	招商证券	201,797	3,690,867.13	0.34
53	601169	北京银行	640,172	3,636,176.96	0.33
54	600015	华夏银行	450,981	3,459,024.27	0.31
55	601012	隆基股份	138,463	3,438,036.29	0.31
56	601111	中国国航	352,581	3,416,509.89	0.31
57	600809	山西汾酒	36,326	3,258,442.20	0.30
58	601117	中国化学	504,327	3,247,865.88	0.30
59	601231	环旭电子	161,778	3,110,990.94	0.28
60	600188	兖州煤业	289,683	3,059,052.48	0.28
61	600340	华夏幸福	106,436	3,054,713.20	0.28
62	600547	山东黄金	92,707	3,024,102.34	0.28
63	600606	绿地控股	429,388	2,984,246.60	0.27
64	600161	天坛生物	105,769	2,955,185.86	0.27
65	600919	江苏银行	407,400	2,949,576.00	0.27
66	600741	华域汽车	113,450	2,948,565.50	0.27
67	600529	山东药玻	106,125	2,933,295.00	0.27
68	600271	航天信息	125,424	2,906,074.08	0.26
69	603338	浙江鼎力	39,881	2,851,491.50	0.26
70	601238	广汽集团	241,456	2,822,620.64	0.26
71	600436	片仔癀	25,637	2,816,737.19	0.26
72	601899	紫金矿业	605,042	2,777,142.78	0.25
73	601985	中国核电	546,000	2,730,000.00	0.25
74	600703	三安光电	146,462	2,689,042.32	0.24
75	600588	用友网络	94,393	2,680,761.20	0.24
76	601881	中国银河	228,604	2,654,092.44	0.24

77	603993	洛阳钼业	605,039	2,637,970.04	0.24
78	600153	建发股份	292,795	2,632,227.05	0.24
79	601009	南京银行	297,576	2,609,741.52	0.24
80	600516	方大炭素	211,950	2,577,312.00	0.23
81	601933	永辉超市	334,517	2,522,258.18	0.23
82	601901	方正证券	289,000	2,505,630.00	0.23
83	600570	恒生电子	31,599	2,456,190.27	0.22
84	600383	金地集团	168,500	2,443,250.00	0.22
85	600089	特变电工	362,119	2,408,091.35	0.22
86	600346	恒力石化	148,089	2,381,271.12	0.22
87	601669	中国电建	538,583	2,337,450.22	0.21
88	600886	国投电力	246,005	2,258,325.90	0.21
89	601877	正泰电器	81,262	2,177,821.60	0.20
90	601808	中海油服	110,897	2,129,222.40	0.19
91	600010	包钢股份	1,583,980	2,090,853.60	0.19
92	600332	白云山	58,477	2,082,365.97	0.19
93	600011	华能国际	369,496	2,061,787.68	0.19
94	603833	欧派家居	17,315	2,025,855.00	0.18
95	600115	东方航空	345,926	2,009,830.06	0.18
96	601633	长城汽车	224,625	1,987,931.25	0.18
97	600061	国投资本	130,503	1,975,815.42	0.18
98	600593	大连圣亚	44,920	1,952,223.20	0.18
99	600196	复星医药	72,991	1,941,560.60	0.18
100	600549	厦门钨业	148,601	1,937,757.04	0.18
101	600406	国电南瑞	91,202	1,931,658.36	0.18
102	600438	通威股份	146,985	1,929,913.05	0.18
103	600023	浙能电力	477,779	1,892,004.84	0.17
104	600201	生物股份	99,746	1,867,245.12	0.17
105	600511	国药股份	67,620	1,845,349.80	0.17
106	601788	光大证券	139,338	1,825,327.80	0.17
107	601727	上海电气	364,492	1,815,170.16	0.17
108	600660	福耀玻璃	75,530	1,811,964.70	0.16
109	603606	东方电缆	163,182	1,791,738.36	0.16
110	600029	南方航空	247,541	1,777,344.38	0.16
111	601018	宁波港	463,574	1,761,581.20	0.16
112	600350	山东高速	356,837	1,752,069.67	0.16
113	601618	中国中冶	624,559	1,748,765.20	0.16
114	600352	浙江龙盛	120,422	1,742,506.34	0.16
115	600926	杭州银行	189,680	1,737,468.80	0.16
116	603799	华友钴业	44,013	1,733,672.07	0.16
117	600967	内蒙一机	160,880	1,710,154.40	0.16

118	600641	万业企业	88,600	1,665,680.00	0.15
119	601377	兴业证券	233,506	1,653,222.48	0.15
120	601098	中南传媒	138,056	1,648,388.64	0.15
121	600098	广州发展	246,557	1,612,482.78	0.15
122	600640	号百控股	62,400	1,610,544.00	0.15
123	600705	中航资本	331,156	1,606,106.60	0.15
124	601898	中煤能源	318,087	1,596,796.74	0.15
125	600795	国电电力	677,728	1,585,883.52	0.14
126	600377	宁沪高速	140,610	1,577,644.20	0.14
127	600893	航发动力	72,752	1,577,263.36	0.14
128	601872	招商轮船	189,108	1,562,032.08	0.14
129	600323	瀚蓝环境	88,692	1,555,657.68	0.14
130	600674	川投能源	155,000	1,526,750.00	0.14
131	603508	思维列控	25,504	1,509,326.72	0.14
132	600085	同仁堂	52,982	1,493,032.76	0.14
133	600663	陆家嘴	109,802	1,483,425.02	0.14
134	600111	北方稀土	135,587	1,469,763.08	0.13
135	600600	青岛啤酒	28,751	1,466,301.00	0.13
136	601919	中远海控	277,429	1,462,050.83	0.13
137	601866	中远海发	562,192	1,456,077.28	0.13
138	600612	老凤祥	30,504	1,452,295.44	0.13
139	600176	中国巨石	131,726	1,435,813.40	0.13
140	601021	春秋航空	32,103	1,409,000.67	0.13
141	600810	神马股份	176,193	1,390,162.77	0.13
142	600850	华东电脑	54,500	1,382,120.00	0.13
143	600390	五矿资本	166,980	1,379,254.80	0.13
144	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.12
145	600236	桂冠电力	278,527	1,361,997.03	0.12
146	600218	全柴动力	121,700	1,360,606.00	0.12
147	601198	东兴证券	103,398	1,358,649.72	0.12
148	600362	江西铜业	79,332	1,343,090.76	0.12
149	601607	上海医药	72,795	1,337,244.15	0.12
150	600862	中航高科	120,697	1,330,080.94	0.12
151	601878	浙商证券	119,398	1,328,899.74	0.12
152	600004	白云机场	75,705	1,321,052.25	0.12
153	600482	中国动力	65,400	1,308,000.00	0.12
154	600177	雅戈尔	185,291	1,291,478.27	0.12
155	600984	建设机械	124,580	1,286,911.40	0.12
156	600398	海澜之家	166,295	1,277,145.60	0.12
157	600233	圆通速递	100,800	1,275,120.00	0.12
158	600649	城投控股	219,625	1,256,255.00	0.11

159	600260	凯乐科技	91,420	1,240,569.40	0.11
160	600637	东方明珠	131,969	1,235,229.84	0.11
161	600597	光明乳业	96,496	1,224,534.24	0.11
162	600064	南京高科	124,540	1,214,265.00	0.11
163	601636	旗滨集团	219,900	1,207,251.00	0.11
164	600583	海油工程	163,420	1,206,039.60	0.11
165	600455	博通股份	34,007	1,195,686.12	0.11
166	600487	亨通光电	73,379	1,193,142.54	0.11
167	600208	新湖中宝	315,610	1,193,005.80	0.11
168	603589	口子窖	21,676	1,190,229.16	0.11
169	600167	联美控股	90,370	1,189,269.20	0.11
170	600038	中直股份	24,806	1,183,494.26	0.11
171	600282	南钢股份	342,900	1,183,005.00	0.11
172	601997	贵阳银行	121,700	1,163,452.00	0.11
173	600068	葛洲坝	171,519	1,145,746.92	0.10
174	600170	上海建工	322,651	1,142,184.54	0.10
175	601992	金隅集团	305,462	1,139,373.26	0.10
176	601600	中国铝业	321,565	1,138,340.10	0.10
177	600584	长电科技	51,671	1,135,728.58	0.10
178	601555	东吴证券	112,892	1,127,791.08	0.10
179	600498	烽火通信	41,048	1,126,767.60	0.10
180	600066	宇通客车	78,999	1,125,735.75	0.10
181	600088	中视传媒	84,472	1,124,322.32	0.10
182	600410	华胜天成	109,000	1,123,790.00	0.10
183	601177	杭齿前进	118,980	1,114,842.60	0.10
184	600368	五洲交通	246,260	1,113,095.20	0.10
185	600461	洪城水业	185,100	1,105,047.00	0.10
186	600299	安迪苏	99,800	1,103,788.00	0.10
187	600273	嘉化能源	97,700	1,099,125.00	0.10
188	603393	新天然气	39,521	1,098,288.59	0.10
189	600027	华电国际	299,175	1,097,972.25	0.10
190	600489	中金黄金	128,743	1,091,740.64	0.10
191	600452	涪陵电力	58,771	1,084,324.95	0.10
192	600369	西南证券	207,878	1,078,886.82	0.10
193	601137	博威合金	95,100	1,070,826.00	0.10
194	600977	中国电影	70,300	1,069,966.00	0.10
195	601966	玲珑轮胎	46,500	1,066,245.00	0.10
196	600885	宏发股份	30,781	1,060,405.45	0.10
197	603008	喜临门	68,500	1,059,695.00	0.10
198	603167	渤海轮渡	98,004	1,057,463.16	0.10
199	600109	国金证券	112,470	1,045,971.00	0.10

200	600688	上海石化	268,894	1,040,619.78	0.09
201	601811	新华文轩	78,600	1,036,734.00	0.09
202	600835	上海机电	62,063	1,028,383.91	0.09
203	603118	共进股份	90,400	1,016,096.00	0.09
204	600633	浙数文化	110,596	1,011,953.40	0.09
205	600559	老白干酒	89,844	1,009,846.56	0.09
206	600675	中华企业	216,395	1,006,236.75	0.09
207	600729	重庆百货	33,676	1,005,228.60	0.09
208	601677	明泰铝业	86,998	1,003,086.94	0.09
209	600510	黑牡丹	149,581	1,002,192.70	0.09
210	600378	天科股份	51,841	1,001,049.71	0.09
211	600118	中国卫星	46,806	1,000,244.22	0.09
212	600668	尖峰集团	63,200	998,560.00	0.09
213	603816	顾家家居	21,819	997,782.87	0.09
214	600839	四川长虹	341,693	994,326.63	0.09
215	603989	艾华集团	45,461	991,959.02	0.09
216	600909	华安证券	135,700	990,610.00	0.09
217	600848	上海临港	40,340	990,347.00	0.09
218	603599	广信股份	66,000	989,340.00	0.09
219	600219	南山铝业	437,949	981,005.76	0.09
220	603919	金徽酒	55,302	979,398.42	0.09
221	600449	宁夏建材	87,700	978,732.00	0.09
222	601212	白银有色	265,800	978,144.00	0.09
223	600628	新世界	103,585	975,770.70	0.09
224	600642	申能股份	167,380	972,477.80	0.09
225	601107	四川成渝	229,525	966,300.25	0.09
226	600448	华纺股份	178,500	965,685.00	0.09
227	600528	中铁工业	83,908	964,942.00	0.09
228	600731	湖南海利	132,600	957,372.00	0.09
229	601958	金钼股份	119,035	953,470.35	0.09
230	600168	武汉控股	142,300	951,987.00	0.09
231	600867	通化东宝	74,947	948,079.55	0.09
232	601099	太平洋	249,737	946,503.23	0.09
233	600020	中原高速	214,901	945,564.40	0.09
234	601158	重庆水务	168,364	942,838.40	0.09
235	600155	华创阳安	66,700	935,801.00	0.09
236	600372	中航电子	65,709	935,696.16	0.09
237	600535	天士力	60,430	931,830.60	0.08
238	600699	均胜电子	51,920	929,368.00	0.08
239	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.08
240	600062	华润双鹤	70,733	923,065.65	0.08

241	600966	博汇纸业	173,677	922,224.87	0.08
242	600522	中天科技	111,073	921,905.90	0.08
243	600073	上海梅林	115,400	919,738.00	0.08
244	600895	张江高科	59,409	909,551.79	0.08
245	601678	滨化股份	177,114	905,052.54	0.08
246	600297	广汇汽车	276,801	902,371.26	0.08
247	600694	大商股份	32,924	901,788.36	0.08
248	601991	大唐发电	367,741	900,965.45	0.08
249	600816	安信信托	202,402	898,664.88	0.08
250	600757	长江传媒	145,807	898,171.12	0.08
251	603663	三祥新材	67,100	897,798.00	0.08
252	600987	航民股份	141,135	893,384.55	0.08
253	600739	辽宁成大	58,348	888,640.04	0.08
254	600998	九州通	62,783	888,379.45	0.08
255	600665	天地源	238,793	883,534.10	0.08
256	600754	锦江股份	30,773	883,492.83	0.08
257	601228	广州港	229,975	880,804.25	0.08
258	600356	恒丰纸业	113,204	877,331.00	0.08
259	600479	千金药业	99,940	876,473.80	0.08
260	600315	上海家化	28,201	872,538.94	0.08
261	601007	金陵饭店	93,500	866,745.00	0.08
262	601900	南方传媒	93,597	866,708.22	0.08
263	600223	鲁商置业	102,350	862,810.50	0.08
264	600521	华海药业	49,500	854,370.00	0.08
265	603979	金诚信	95,400	851,922.00	0.08
266	600603	广汇物流	171,840	850,608.00	0.08
267	600488	天药股份	203,800	847,808.00	0.08
268	600229	城市传媒	119,300	847,030.00	0.08
269	600873	梅花生物	189,731	844,302.95	0.08
270	603100	川仪股份	95,078	844,292.64	0.08
271	600750	江中药业	67,103	840,800.59	0.08
272	600704	物产中大	159,392	836,808.00	0.08
273	600409	三友化工	131,926	833,772.32	0.08
274	600114	东睦股份	97,088	833,015.04	0.08
275	600057	厦门象屿	200,683	832,834.45	0.08
276	600351	亚宝药业	142,691	831,888.53	0.08
277	601699	潞安环能	114,305	829,854.30	0.08
278	603018	中设集团	80,456	827,892.24	0.08
279	600336	澳柯玛	187,882	824,801.98	0.08
280	600256	广汇能源	249,046	824,342.26	0.08
281	600325	华发股份	105,162	823,418.46	0.07

282	600203	福日电子	128,500	822,400.00	0.07
283	600589	广东榕泰	150,900	820,896.00	0.07
284	600287	江苏舜天	135,400	816,462.00	0.07
285	600345	长江通信	36,200	816,310.00	0.07
286	600127	金健米业	203,200	814,832.00	0.07
287	600258	首旅酒店	39,423	812,508.03	0.07
288	600819	耀皮玻璃	158,700	807,783.00	0.07
289	600673	东阳光	78,052	799,252.48	0.07
290	600971	恒源煤电	133,646	799,203.08	0.07
291	601579	会稽山	93,100	796,936.00	0.07
292	600566	济川药业	32,600	788,268.00	0.07
293	600790	轻纺城	231,780	788,052.00	0.07
294	600658	电子城	148,764	785,473.92	0.07
295	600811	东方集团	233,252	783,726.72	0.07
296	603869	新智认知	65,635	782,369.20	0.07
297	600976	健民集团	43,902	780,138.54	0.07
298	600128	弘业股份	103,305	777,886.65	0.07
299	600279	重庆港九	169,100	777,860.00	0.07
300	601689	拓普集团	44,462	774,972.66	0.07
301	600283	钱江水利	74,000	774,040.00	0.07
302	600853	龙建股份	242,551	771,312.18	0.07
303	600376	首开股份	95,741	763,055.77	0.07
304	600578	京能电力	243,911	761,002.32	0.07
305	601128	常熟银行	83,505	760,730.55	0.07
306	603025	大豪科技	80,260	760,062.20	0.07
307	600106	重庆路桥	243,588	757,558.68	0.07
308	600308	华泰股份	164,825	756,546.75	0.07
309	600708	光明地产	214,169	753,874.88	0.07
310	600375	华菱星马	160,800	752,544.00	0.07
311	603698	航天工程	59,858	752,415.06	0.07
312	600823	世茂股份	166,980	751,410.00	0.07
313	603515	欧普照明	26,703	750,621.33	0.07
314	601518	吉林高速	282,056	744,627.84	0.07
315	603726	朗迪集团	63,635	744,529.50	0.07
316	600557	康缘药业	50,475	744,001.50	0.07
317	601339	百隆东方	185,700	740,943.00	0.07
318	603090	宏盛股份	45,200	740,376.00	0.07
319	600160	巨化股份	101,629	739,859.12	0.07
320	600415	小商品城	190,873	738,678.51	0.07
321	601598	中国外运	172,865	736,404.90	0.07
322	600573	惠泉啤酒	110,500	733,720.00	0.07

323	601216	君正集团	233,650	731,324.50	0.07
324	600697	欧亚集团	41,200	731,300.00	0.07
325	600713	南京医药	155,896	729,593.28	0.07
326	601199	江南水务	192,294	728,794.26	0.07
327	600210	紫江企业	193,237	728,503.49	0.07
328	601928	凤凰传媒	95,085	723,596.85	0.07
329	600497	驰宏锌锗	164,685	721,320.30	0.07
330	600894	广日股份	95,699	718,699.49	0.07
331	600400	红豆股份	213,260	716,553.60	0.07
332	600361	华联综超	189,189	715,134.42	0.07
333	600007	中国国贸	40,859	715,032.50	0.07
334	600373	中文传媒	52,262	711,285.82	0.06
335	600327	大东方	201,819	710,402.88	0.06
336	601118	海南橡胶	144,187	709,400.04	0.06
337	601188	龙江交通	234,000	709,020.00	0.06
338	600079	人福医药	52,096	703,816.96	0.06
339	600382	广东明珠	100,610	703,263.90	0.06
340	600100	同方股份	80,122	702,669.94	0.06
341	600973	宝胜股份	184,600	701,480.00	0.06
342	601218	吉鑫科技	246,072	698,844.48	0.06
343	600618	氯碱化工	93,900	693,921.00	0.06
344	600875	东方电气	75,199	691,078.81	0.06
345	601611	中国核建	96,900	690,897.00	0.06
346	600339	中油工程	203,389	689,488.71	0.06
347	600982	宁波热电	227,900	688,258.00	0.06
348	603306	华懋科技	49,605	686,037.15	0.06
349	600561	江西长运	117,400	685,616.00	0.06
350	603788	宁波高发	41,424	685,152.96	0.06
351	600858	银座股份	132,500	685,025.00	0.06
352	600796	钱江生化	125,882	682,280.44	0.06
353	603798	康普顿	49,400	680,732.00	0.06
354	601179	中国西电	186,219	677,837.16	0.06
355	600808	马钢股份	220,630	677,334.10	0.06
356	603077	和邦生物	457,315	676,826.20	0.06
357	600577	精达股份	247,360	675,292.80	0.06
358	600820	隧道股份	111,490	673,399.60	0.06
359	600742	一汽富维	55,694	673,340.46	0.06
360	603898	好莱客	41,102	671,606.68	0.06
361	601126	四方股份	120,300	666,462.00	0.06
362	601599	鹿港文化	199,023	660,756.36	0.06
363	600268	国电南自	128,429	660,125.06	0.06

364	600300	维维股份	223,290	658,705.50	0.06
365	603020	爱普股份	79,900	656,778.00	0.06
366	600021	上海电力	81,266	654,191.30	0.06
367	600598	北大荒	66,995	652,531.30	0.06
368	600864	哈投股份	80,800	651,248.00	0.06
369	600502	安徽水利	160,340	650,980.40	0.06
370	600312	平高电气	99,873	645,179.58	0.06
371	600586	金晶科技	222,698	641,370.24	0.06
372	600567	山鹰纸业	169,200	637,884.00	0.06
373	601333	广深铁路	206,951	633,270.06	0.06
374	600331	宏达股份	240,527	632,586.01	0.06
375	600126	杭钢股份	128,450	628,120.50	0.06
376	600986	科达股份	126,020	625,059.20	0.06
377	600392	盛和资源	68,894	624,868.58	0.06
378	600854	春兰股份	163,900	624,459.00	0.06
379	600784	鲁银投资	118,800	622,512.00	0.06
380	600676	交运股份	143,500	619,920.00	0.06
381	603818	曲美家居	74,096	619,442.56	0.06
382	600333	长春燃气	118,909	618,326.80	0.06
383	603225	新凤鸣	49,907	616,351.45	0.06
384	600099	林海股份	92,700	615,528.00	0.06
385	600879	航天电子	102,100	610,558.00	0.06
386	600475	华光股份	61,000	609,390.00	0.06
387	600527	江南高纤	291,204	608,616.36	0.06
388	600884	杉杉股份	44,894	606,517.94	0.06
389	600317	营口港	237,674	606,068.70	0.06
390	600348	阳泉煤业	109,507	605,573.71	0.06
391	601608	中信重工	162,585	604,816.20	0.06
392	603159	上海亚虹	52,142	603,282.94	0.05
393	600180	瑞茂通	86,296	602,346.08	0.05
394	600480	凌云股份	77,731	596,974.08	0.05
395	601127	小康股份	52,300	596,220.00	0.05
396	600008	首创股份	180,400	593,516.00	0.05
397	601168	西部矿业	89,469	592,284.78	0.05
398	600664	哈药股份	155,156	588,041.24	0.05
399	600266	北京城建	72,375	586,237.50	0.05
400	601880	大连港	286,260	581,107.80	0.05
401	603001	奥康国际	63,800	574,200.00	0.05
402	601000	唐山港	220,700	573,820.00	0.05
403	600243	青海华鼎	130,300	572,017.00	0.05
404	600761	安徽合力	58,503	569,234.19	0.05

405	600827	百联股份	62,685	562,911.30	0.05
406	600022	山东钢铁	392,318	561,014.74	0.05
407	600718	东软集团	49,192	558,329.20	0.05
408	600080	金花股份	92,394	557,135.82	0.05
409	601616	广电电气	180,334	550,018.70	0.05
410	600500	中化国际	103,647	549,329.10	0.05
411	600655	豫园股份	69,841	547,553.44	0.05
412	601375	中原证券	101,800	545,648.00	0.05
413	600056	中国医药	41,804	545,542.20	0.05
414	600758	红阳能源	125,600	545,104.00	0.05
415	600067	冠城大通	135,432	539,019.36	0.05
416	601717	郑煤机	82,887	536,278.89	0.05
417	600777	新潮能源	255,199	535,917.90	0.05
418	601718	际华集团	162,878	530,982.28	0.05
419	600090	同济堂	126,190	527,474.20	0.05
420	600051	宁波联合	85,892	515,352.00	0.05
421	600889	南京化纤	110,300	509,586.00	0.05
422	603766	隆鑫通用	136,392	508,742.16	0.05
423	600393	粤泰股份	183,990	496,773.00	0.05
424	600975	新五丰	61,280	492,691.20	0.04
425	600468	百利电气	132,712	491,034.40	0.04
426	600435	北方导航	58,896	490,014.72	0.04
427	600717	天津港	76,853	482,636.84	0.04
428	600239	云南城投	163,250	471,792.50	0.04
429	600338	西藏珠峰	37,563	469,537.50	0.04
430	600623	华谊集团	70,500	468,825.00	0.04
431	600037	歌华有线	51,937	467,952.37	0.04
432	600200	江苏吴中	85,500	459,990.00	0.04
433	600551	时代出版	55,410	454,362.00	0.04
434	601208	东材科技	91,070	448,064.40	0.04
435	600657	信达地产	110,811	442,135.89	0.04
436	600594	益佰制药	88,300	439,734.00	0.04
437	601066	中信建投	14,390	437,456.00	0.04
438	601969	海南矿业	74,000	428,460.00	0.04
439	600277	亿利洁能	91,600	417,696.00	0.04
440	601801	皖新传媒	75,600	414,288.00	0.04
441	600693	东百集团	77,697	406,355.31	0.04
442	600881	亚泰集团	125,565	400,552.35	0.04
443	600261	阳光照明	83,824	398,164.00	0.04
444	600908	无锡银行	70,800	392,940.00	0.04
445	600291	西水股份	43,300	389,267.00	0.04

446	600685	中船防务	26,287	387,733.25	0.04
447	600293	三峡新材	118,400	371,776.00	0.03
448	600123	兰花科创	54,985	353,003.70	0.03
449	601515	东风股份	51,039	344,513.25	0.03
450	600284	浦东建设	54,083	343,427.05	0.03
451	600682	南京新百	32,500	328,575.00	0.03
452	600978	宜华生活	109,700	325,809.00	0.03
453	600306	商业城	56,700	322,623.00	0.03
454	600525	长园集团	50,958	302,180.94	0.03
455	600804	鹏博士	37,950	232,254.00	0.02
456	601990	南京证券	9,916	128,015.56	0.01
457	601003	柳钢股份	22,197	125,413.05	0.01
458	601828	美凯龙	10,405	117,888.65	0.01
459	600901	江苏租赁	18,435	116,509.20	0.01
460	600829	人民同泰	7,343	50,079.26	0.00
461	600267	海正药业	88	872.08	0.00
462	600138	中青旅	42	529.20	0.00
463	600162	香江控股	23	52.67	0.00

1.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.02
2	688198	佰仁医疗	3,213	120,744.54	0.01
3	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601658	邮储银行	6,258,824.00	0.47
2	601288	农业银行	5,360,838.00	0.40
3	600036	招商银行	4,587,422.00	0.34
4	600519	贵州茅台	4,489,791.00	0.34
5	601857	中国石油	4,223,973.00	0.32
6	601988	中国银行	4,179,043.00	0.31
7	601318	中国平安	3,493,509.03	0.26
8	601628	中国人寿	2,313,749.99	0.17
9	601328	交通银行	2,080,191.00	0.16

10	601916	浙商银行	2,076,173.32	0.16
11	600028	中国石化	1,963,292.00	0.15
12	601939	建设银行	1,578,237.00	0.12
13	601077	渝农商行	1,553,776.96	0.12
14	600900	长江电力	1,517,625.00	0.11
15	601166	兴业银行	1,504,862.00	0.11
16	600000	浦发银行	1,263,568.00	0.09
17	601088	中国神华	1,200,338.99	0.09
18	600276	恒瑞医药	1,150,693.00	0.09
19	600104	上汽集团	1,120,823.00	0.08
20	603288	海天味业	1,016,644.00	0.08

注:本项“买入金额”按买入成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601857	中国石油	29,229,578.00	2.19
2	601288	农业银行	28,536,361.06	2.13
3	600036	招商银行	23,554,060.73	1.76
4	600519	贵州茅台	22,785,054.27	1.70
5	601988	中国银行	22,116,834.52	1.65
6	601318	中国平安	17,945,815.44	1.34
7	601628	中国人寿	12,168,874.85	0.91
8	601328	交通银行	11,089,891.38	0.83
9	600028	中国石化	10,618,293.00	0.79
10	601939	建设银行	8,384,229.49	0.63
11	600900	长江电力	7,978,096.26	0.60
12	601166	兴业银行	7,798,890.14	0.58
13	600000	浦发银行	6,675,289.00	0.50
14	601088	中国神华	6,521,918.10	0.49
15	600104	上汽集团	6,083,989.02	0.45
16	600276	恒瑞医药	5,957,626.56	0.45
17	603288	海天味业	5,145,090.12	0.38
18	601668	中国建筑	5,125,465.20	0.38
19	601601	中国太保	4,687,913.99	0.35
20	600016	民生银行	4,501,655.00	0.34

注:本项“卖出金额”按卖出成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	122,517,254.21
卖出股票收入(成交)总额	605,930,741.10

注:本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期内未投资贵金属。

1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未有投资股指期货。

1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

1.12 投资组合报告附注

1.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	85,330.52
2	应收证券清算款	719,591.21
3	应收股利	-
4	应收利息	11,761.69

5	应收申购款	860,339.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,677,023.09

1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

1.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688181	八亿时空	189,377.88	0.02	新股流通受限
2	688198	佰仁医疗	120,744.54	0.01	新股流通受限

十二、基金的业绩

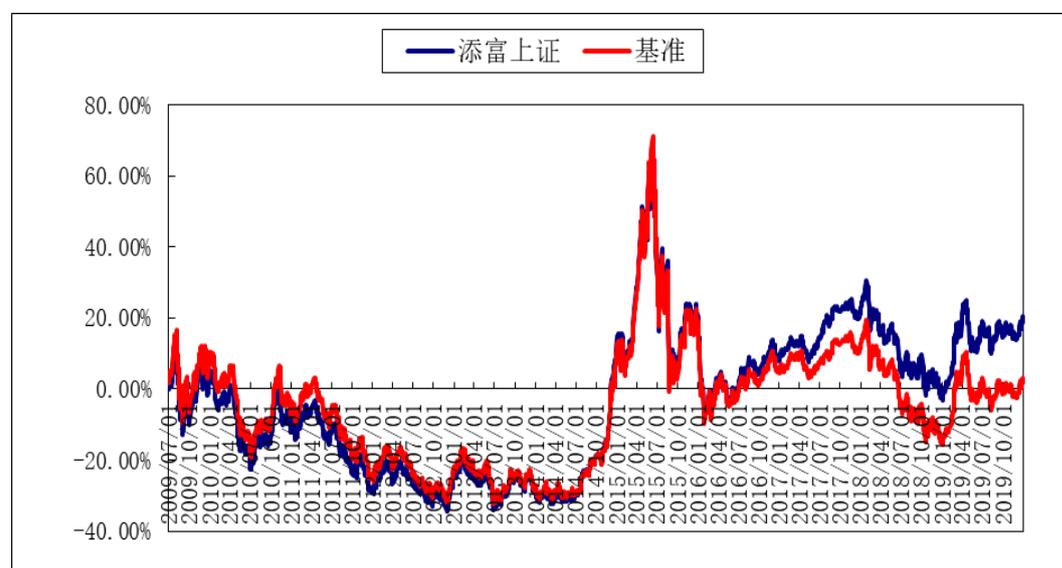
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2009年7月1日(基金合同生效日)至2009年12月31日	5.10%	1.88%	10.21%	1.89%	-5.11%	-0.01%
2010年1月1日至2010年12月31日	-14.37%	1.38%	-13.58%	1.35%	-0.79%	0.03%
2011年1月1日至2011年12月31日	-20.11%	1.10%	-20.57%	1.10%	0.46%	0.00%

2012年1月1日至 2012年12月31日	5.70%	1.04%	3.03%	1.04%	2.67%	0.00%
2013年1月1日至 2013年12月31日	-5.26%	1.15%	-6.39%	1.10%	1.13%	0.05%
2014年1月1日至 2014年12月31日	54.03%	1.05%	50.24%	1.03%	3.79%	0.02%
2015年1月1日至 2015年12月31日	8.33%	2.44%	8.96%	2.32%	-0.63%	0.12%
2016年1月1日至 2016年12月31日	-9.89%	1.36%	-11.67%	1.38%	1.78%	-0.02%
2017年1月1日至 2017年12月31日	11.86%	0.50%	6.25%	0.52%	5.61%	-0.02%
2018年1月1日至 2018年12月31日	-19.10%	1.13%	-23.34%	1.17%	4.24%	-0.04%
2019年1月1日至 2019年12月31日	22.84%	1.04%	21.21%	1.08%	1.63%	-0.04%
2009年7月1日(基金 合同生效日)至 2019年12月31日	20.32%	1.34%	3.11%	1.32%	17.21%	0.02%

(二)自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图



十三、基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金基金合同终止基金财产清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述基金费用的种类中第 3—7 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒介上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

（一）根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订，更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

（二）针对“基金管理人”章节：更新了基金管理人的相关信息。

（三）针对“基金托管人”章节：更新了基金托管人的相关信息。

- (四) 针对“基金的投资”章节：更新了基金的投资组合报告。
- (五) 针对“基金的业绩”章节：更新了基金的业绩。
- (六) 针对“其他应披露事项”章节：更新了本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司

2020年4月14日